



LDB
EMPRESAS

LINHARES
JULHO 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 25.08.2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 91,11%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

| Emissor | Título Público | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira |
|--|--------------------------|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (3,200000%) | 2,94 | -0,09 | 3,50 | 956.129,41 | 0,32 |
| TESOURO NACIONAL | NTN-B 150535 (4,410000%) | 37,65 | 0,01 | 4,42 | 1.024.366,66 | 0,35 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a | | 20,56 | -0,04 | 3,96 | 1.980.496,07 | 0,67 |

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--|----------|---|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|-------------------|---------|
| BANESTES | BANESTES | BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B | 22,79 | 7,49 | -1,55 | 34.553.543,62 | 11,67 | 336.367.162,90 | 10,27 |
| BB | BB | BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | 0,54 | 0,23 | 2,69 | 14.111.155,10 | 4,77 | 7.835.713.656,67 | 0,18 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 12,47 | 4,36 | 2,54 | 17.217.771,13 | 5,82 | 5.823.784.558,48 | 0,30 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 12,54 | 4,38 | 2,42 | 17.506.640,83 | 5,91 | 6.313.416.954,01 | 0,28 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,53 | 0,24 | 2,73 | 26.771.161,87 | 9,04 | 10.907.406.871,77 | 0,25 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 4,95 | 0,97 | 4,05 | 9.477.089,80 | 3,20 | 12.027.903.790,65 | 0,08 |
| BB | BB | BB PREV RF IDKA2 | 4,11 | 0,81 | 3,71 | 6.211.497,42 | 2,10 | 6.099.396.938,17 | 0,10 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO | 8,70 | 1,50 | 7,47 | 2.279.048,92 | 0,77 | 3.049.933.927,01 | 0,07 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP | 4,02 | 0,83 | 3,97 | 9.221.012,64 | 3,11 | 7.954.778.997,85 | 0,12 |
| BB | BB | BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | 4,92 | 0,97 | 4,08 | 6.386.031,02 | 2,16 | 4.153.926.563,49 | 0,15 |
| BANESTES | BANESTES | BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 | 4,17 | 0,67 | 5,55 | 15.467.112,86 | 5,22 | 179.782.214,33 | 8,60 |
| BB | BB | BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI | 5,12 | 0,96 | 3,89 | 4.032.305,74 | 1,36 | 565.461.999,50 | 0,71 |
| BB | BB | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 6,08 | 1,77 | 3,55 | 12.735.524,22 | 4,30 | 10.799.663.748,52 | 0,12 |
| CEF | CEF | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 5,95 | 0,98 | 5,65 | 1.441.015,32 | 0,49 | 12.451.209.797,34 | 0,01 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF | 1,19 | 0,07 | 0,81 | 823.033,23 | 0,28 | 1.000.769.936,56 | 0,08 |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b | | | 6,22 | 2,68 | 2,41 | 178.233.943,72 | 60,21 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|----------|--|---------------------|-----------------|-----------------|-----------------------|--------------|------------------|---------|
| BANESTES | BANESTES | BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI | 0,99 | 0,55 | -1,09 | 19.183.187,39 | 6,48 | 316.989.364,17 | 6,05 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP | 0,19 | 0,19 | 2,02 | 1.136.790,47 | 0,38 | 5.369.451.851,24 | 0,02 |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,29 | 0,25 | 1,62 | 12.178.328,64 | 4,11 | 4.665.137.027,34 | 0,26 |
| BANESTES | BANESTES | BANESTES INSTITUCIONAL FI RF | 25,96 | 6,59 | -2,31 | 16.007.399,11 | 5,41 | 311.642.335,02 | 5,14 |
| BB | BB | BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | 0,17 | 0,24 | 1,61 | 24.446.416,65 | 8,26 | 2.412.408.451,26 | 1,01 |
| BANESTES | BANESTES | BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF | 2,54 | 1,86 | 0,53 | 11.126.020,96 | 3,76 | 182.307.109,20 | 6,10 |
| BB | BB | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 7,67 | 1,66 | 2,52 | 5.424.541,66 | 1,83 | 1.203.931.832,99 | 0,45 |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a | | | 4,54 | 1,68 | 0,25 | 89.502.684,88 | 30,23 | | |
| Renda Fixa | | | 5,33 | 2,33 | 1,70 | 269.717.124,67 | 91,11 | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

8,89%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|---|----------|--|---------------------|-----------------|-----------------|----------------------|-------------|----------------|---------|
| CEF | CEF | FIA CAIXA DIVIDENDOS | 38,46 | 4,48 | -17,54 | 1.618.044,80 | 0,55 | 284.997.557,13 | 0,57 |
| VINCI | CEF | FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 39,01 | 8,32 | -9,87 | 15.563.498,97 | 5,26 | 862.156.434,48 | 1,81 |
| BANESTES | BANESTES | BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL | 45,00 | 8,36 | -0,70 | 6.405.014,48 | 2,16 | 154.315.606,33 | 4,15 |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a | | | 39,80 | 8,06 | -8,10 | 23.586.558,25 | 7,97 | | |

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

| Gestor | Admin. | Ativo | Volatilid. a.a. (%) | Rentab. Mês (%) | Rentab. Ano (%) | Valor (R\$) | % Carteira | PL do Fundo | % Fundo |
|--------------------------------|--------|---|---------------------|-----------------|-----------------|---------------------|-------------|------------------|---------|
| CEF | CEF | FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO | 12,80 | 2,44 | -0,74 | 2.721.648,95 | 0,92 | 2.446.471.418,84 | 0,11 |
| Sub-total Artigo 8º III | | | 12,80 | 2,44 | -0,74 | 2.721.648,95 | 0,92 | | |

| | | | | | | | | | |
|--|--|--|--------------|-------------|--------------|----------------------|-------------|--|--|
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | 36,71 | 7,45 | -7,47 | 26.308.207,20 | 8,89 | | |
|--|--|--|--------------|-------------|--------------|----------------------|-------------|--|--|

| | | | | | | | | | |
|--------------|--|--|--|--|--|-----------------------|---------------|--|--|
| Total | | | | | | 296.025.331,87 | 100,00 | | |
|--------------|--|--|--|--|--|-----------------------|---------------|--|--|

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

| Artigo | Tipo de Ativo | Valor(R\$) | % Carteira | Política de Investimentos | | | |
|--|--|-----------------------|--------------|---------------------------|----------|--------|--------------|
| | | | | Mínimo | Objetivo | Máximo | Limite Legal |
| Renda Fixa | | | | | | | |
| Artigo 7º I, Alínea a | Títulos do Tesouro Nacional | 1.980.496,07 | 0,67 | 0,00 | 3,00 | 100,00 | 100,00 |
| Artigo 7º I, Alínea b | Fundos 100% Títulos Públicos | 178.233.943,72 | 60,21 | 0,00 | 53,00 | 100,00 | 100,00 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | Fundos de Renda Fixa | 89.502.684,88 | 30,23 | 0,00 | 20,00 | 40,00 | 40,00 |
| | Total Renda Fixa | 269.717.124,67 | 91,11 | | | | |
| Renda Variável e Investimentos Estruturados | | | | | | | |
| Artigo 8º II, Alínea a | Fundos de Ações | 23.586.558,25 | 7,97 | 0,00 | 14,00 | 20,00 | 20,00 |
| Artigo 8º III | Fundos Multimercados | 2.721.648,95 | 0,92 | 0,00 | 8,00 | 10,00 | 10,00 |
| | Total Renda Variável e Investimentos Estruturados | 26.308.207,20 | 8,89 | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

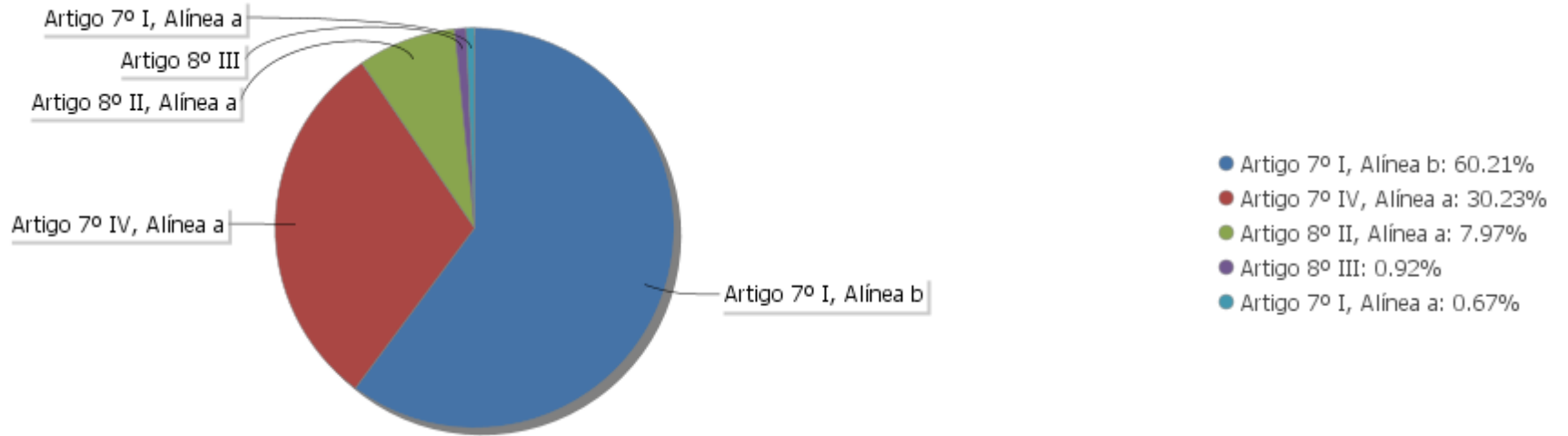
| Estratégia Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | No Mês(R\$) | No Ano(R\$) |
|--|------------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|--------------|---------------|
| Artigo 7º I, Alínea a % do CDI | -0,04 -19,65 | 3,96 203,10 | 1,54 238,52 | 2,45 155,88 | 11,61 275,52 | -756,67 | 74.703,10 |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 2,68 1.378,29 | 2,41 123,29 | 5,09 790,69 | 1,95 124,24 | 6,72 159,54 | 4.648.863,23 | 4.185.273,56 |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 1,68 866,61 | 0,25 12,63 | 2,91 452,29 | -0,20 -12,82 | 2,89 68,68 | 1.454.204,53 | 287.583,72 |
| Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p. | 8,06 -0,21 | -8,10 2,91 | 23,43 -4,40 | -9,64 -0,11 | 6,12 5,04 | 1.758.414,05 | -2.249.621,00 |
| Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p. | 2,44 -5,83 | -0,74 10,27 | 7,71 -20,12 | -0,49 9,04 | 5,48 4,40 | 64.738,80 | -20.352,47 |
| | | | | | | 7.925.463,94 | 2.277.586,91 |

Análise de Liquidez

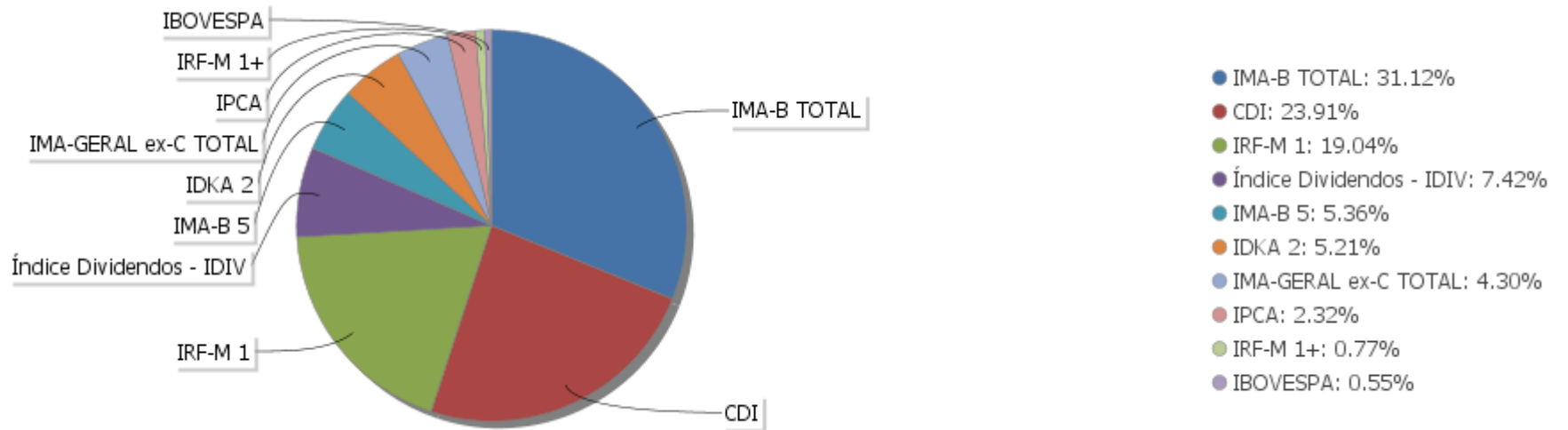
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acumulado (R\$) | (%) Acum. |
|-------------------|----------------|-------|-----------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 268.044.016,61 | 90,55 | 268.044.016,61 | 90,55 |
| de 31 a 364 dias | 21.968.513,45 | 7,42 | 290.012.530,06 | 97,97 |
| acima de 365 dias | 6.012.801,81 | 2,03 | 296.025.331,87 | 100,00 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

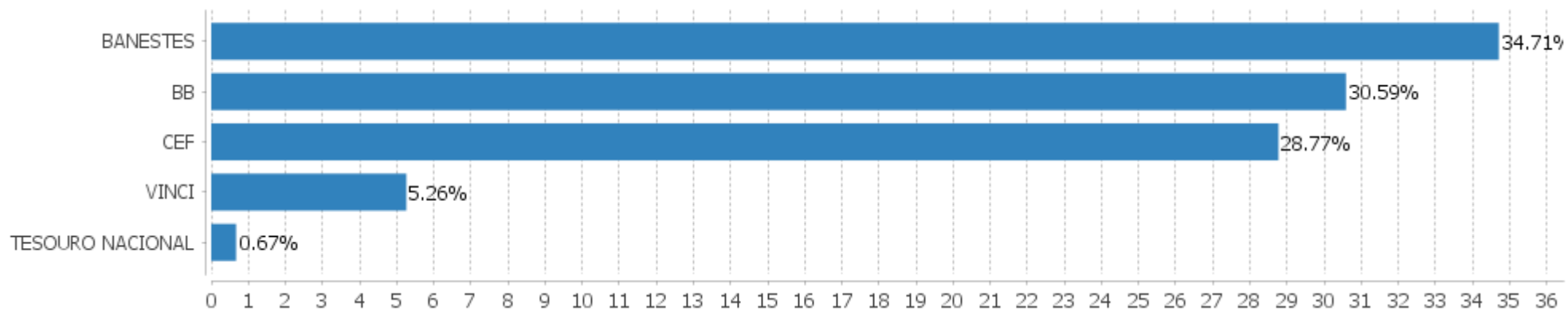


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

| Ano | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Rent.Ano |
|----------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-------|-------|------|-------|-------|----------|
| 2020 | 0,49 | -0,30 | -6,00 | 1,19 | 1,40 | 1,41 | 2,77 | | | | | | 0,71 |
| INPC + 6% | 0,70 | 0,59 | 0,69 | 0,23 | 0,21 | 0,79 | 0,98 | | | | | | 4,26 |
| p.p. indexador | -0,21 | -0,89 | -6,69 | 0,96 | 1,19 | 0,63 | 1,79 | | | | | | -3,55 |
| 2019 | 2,03 | 0,57 | 0,45 | 0,98 | 2,17 | 2,28 | 1,23 | -0,12 | 1,94 | 2,06 | -1,14 | 1,47 | 14,79 |
| INPC + 6% | 0,87 | 1,01 | 1,21 | 1,09 | 0,66 | 0,45 | 0,63 | 0,63 | 0,44 | 0,57 | 1,01 | 1,71 | 10,78 |
| p.p. indexador | 1,15 | -0,43 | -0,77 | -0,11 | 1,51 | 1,83 | 0,60 | -0,75 | 1,50 | 1,49 | -2,14 | -0,25 | 4,02 |
| 2018 | 3,06 | 0,59 | 0,52 | 0,09 | -2,34 | -0,08 | 1,29 | 0,01 | 0,40 | 3,08 | 0,67 | 1,06 | 8,56 |
| INPC + 6% | 0,74 | 0,60 | 0,56 | 0,70 | 0,92 | 1,92 | 0,76 | 0,53 | 0,74 | 0,91 | 0,21 | 0,60 | 9,59 |
| p.p. indexador | 2,32 | -0,01 | -0,04 | -0,60 | -3,25 | -2,00 | 0,53 | -0,53 | -0,34 | 2,17 | 0,46 | 0,46 | -1,03 |

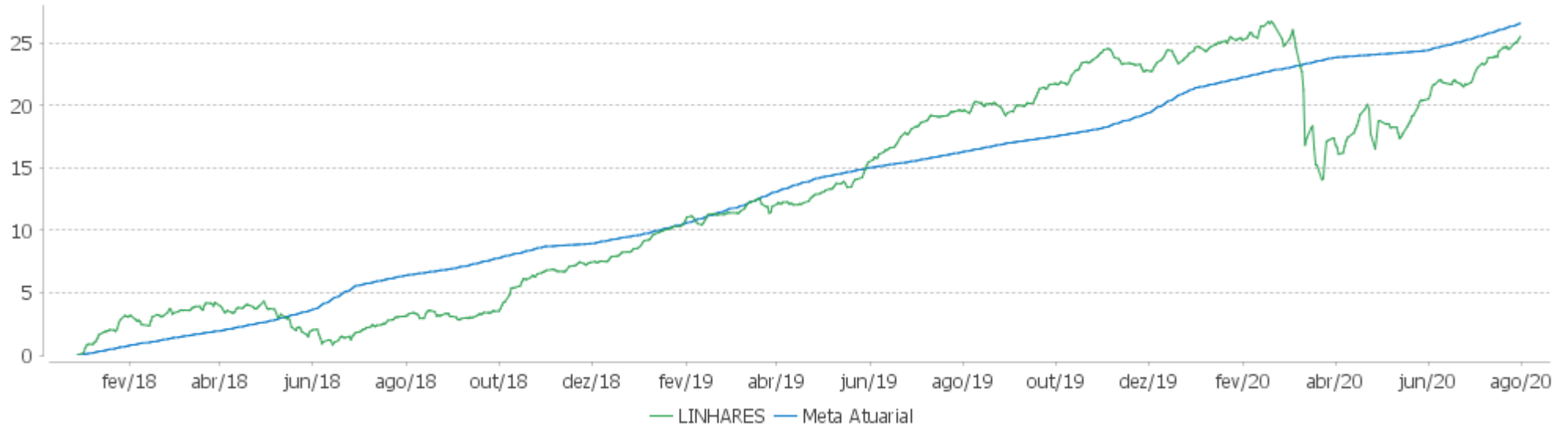
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

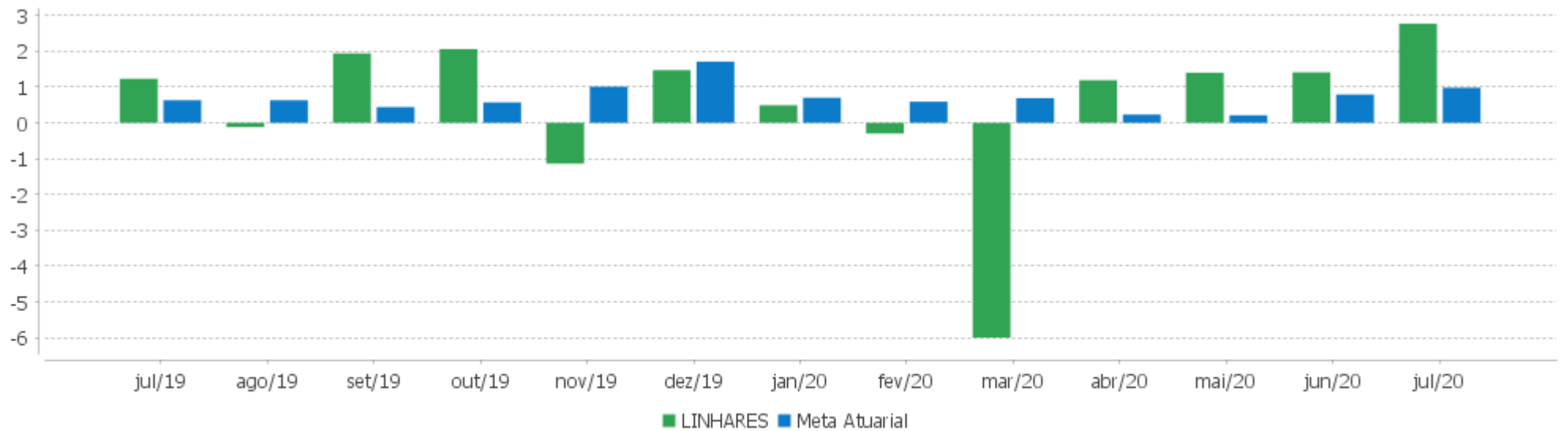
| | Quantidade | Perc. (%) | Período | Carteira | Meta Atuarial | p.p. Indx. | Volatilidade Anual |
|---------------------------------|------------|-----------|------------------|----------|---------------|------------|--------------------|
| Meses acima da Meta Atuarial | 15 | 48,39 | 03 meses | 5,69 | 1,99 | 3,70 | 3,01 |
| Meses abaixo da Meta Atuarial | 16 | 51,61 | 06 meses | 0,22 | 3,54 | -3,31 | 8,80 |
| | | | 12 meses | 4,99 | 8,88 | -3,89 | 6,35 |
| | | | 24 meses | 21,74 | 19,01 | 2,73 | 4,71 |
| | | | 36 meses | | | | |
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,08 | 2018-10 | | | | | |
| Menor rentabilidade da Carteira | -6,00 | 2020-03 | Desde 29/12/2017 | 25,51 | 26,57 | -1,06 | 4,37 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|----------------|-----------------|----------------|-----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RF Var. IMA-B TOTAL p.p. | 6,59 2,20 | -2,31 -4,96 | 10,55 2,41 | -3,03 -5,41 | 2,22 -5,94 | 38,94 1,08 | 44,06 -2,69 |
| BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI % do CDI | 0,55 282,46 | -1,09 -55,85 | 1,33 205,90 | -1,43 -90,82 | 1,02 24,21 | 7,23 66,79 | 14,67 78,56 |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF % do CDI | 1,86 959,39 | 0,53 27,26 | 2,86 443,55 | -0,08 -5,26 | 6,90 163,77 | 26,22 242,12 | |
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI | 0,24 121,46 | 1,61 82,50 | 0,75 117,07 | 1,26 80,04 | 3,74 88,70 | 10,19 94,14 | 18,03 96,53 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI Var. IPCA p.p. | 1,92 1,56 | 4,90 4,94 | 4,09 3,86 | | | | |
| FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP % do CDI | 0,19 95,99 | 2,02 103,41 | 0,66 102,26 | 1,63 103,60 | 4,26 101,03 | 10,76 99,34 | 18,44 98,71 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI | 0,25 127,85 | 1,62 83,02 | 0,82 127,63 | 1,25 79,33 | 3,72 88,18 | 10,14 93,65 | 17,77 95,15 |
| NTN-B 150535 (4,410000%) Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,01 -4,37 | 4,42 1,77 | 1,79 -6,35 | 2,84 0,46 | 17,13 8,97 | 23,24 -14,62 | |
| NTN-B 150535 (3,200000%) Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,09 -4,48 | 3,50 0,85 | 1,28 -6,87 | 2,04 -0,34 | 3,55 -4,61 | 5,70 -32,17 | |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B TOTAL p.p. | 4,38 -0,01 | 2,42 -0,23 | 8,09 -0,05 | 2,17 -0,22 | 7,72 -0,43 | 37,07 -0,79 | 45,56 -1,19 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p. | 0,97 -0,02 | 4,05 -0,15 | 4,23 -0,05 | 3,48 -0,13 | 8,54 -0,29 | 23,61 -0,55 | 33,54 -0,89 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p. | 0,23 -0,01 | 2,69 -0,15 | 0,88 -0,06 | 2,26 -0,13 | 5,22 -0,29 | 12,65 -0,54 | 20,70 -0,86 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. IMA-B 5 p.p. | 0,97 -0,02 | 4,08 -0,11 | 4,20 -0,08 | 3,51 -0,11 | 8,59 -0,24 | 23,64 -0,51 | 33,60 -0,83 |
| FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,07 -4,32 | 0,81 -1,84 | 1,77 -6,37 | 0,84 -1,54 | 4,20 -3,95 | 14,12 -23,74 | 20,80 -25,96 |
| BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI Var. IMA-B TOTAL p.p. | 0,96 -3,42 | 3,89 1,24 | 4,30 -3,84 | 3,34 0,96 | 8,45 0,30 | 25,43 -12,44 | 35,39 -11,36 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO Var. IRF-M 1+ p.p. | 1,50 0,03 | 7,47 -0,12 | 4,47 -0,03 | 6,32 -0,08 | 11,77 -0,24 | 32,19 -0,62 | 42,77 -1,01 |
| BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 | 0,67 | 5,55 | 1,97 | 4,80 | 8,68 | 21,03 | 30,55 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Fundo Variação da Estratégia | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|---|-------------|---------------|--------------|---------------|--------------|--------------|--------------|
| Var. IRF-M 1 p.p. | 0,44 | 2,71 | 1,03 | 2,41 | 3,18 | 7,83 | 8,99 |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B | 7,49 | -1,55 | 10,74 | -2,09 | 4,08 | 44,21 | 49,90 |
| Var. IMA-B TOTAL p.p. | 3,11 | -4,20 | 2,60 | -4,47 | -4,07 | 6,35 | 3,15 |
| BB PREV RF IDKA2 | 0,81 | 3,71 | 4,07 | 3,32 | 7,99 | 20,62 | 30,76 |
| Var. IDKA 2 p.p. | -0,13 | -0,60 | 0,35 | -0,44 | -0,69 | -1,75 | -2,60 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | 1,77 | 3,55 | 3,83 | 3,05 | 7,10 | 23,78 | 32,81 |
| Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | 0,11 | 0,15 | 0,26 | 0,17 | 0,02 | 0,51 | 0,56 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 0,98 | 5,65 | 3,14 | 4,79 | 9,68 | 28,24 | 37,15 |
| Var. IPCA p.p. | 0,62 | 5,19 | 2,90 | 4,54 | 7,38 | 22,64 | 26,81 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | 0,83 | 3,97 | 3,96 | 3,50 | 8,10 | 20,93 | 31,10 |
| Var. IDKA 2 p.p. | -0,11 | -0,34 | 0,24 | -0,26 | -0,58 | -1,44 | -2,25 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | 4,36 | 2,54 | 8,07 | 2,27 | 7,94 | 37,20 | 45,69 |
| Var. IMA-B TOTAL p.p. | -0,02 | -0,11 | -0,07 | -0,11 | -0,22 | -0,66 | -1,07 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | 0,24 | 2,73 | 0,90 | 2,30 | 5,30 | 12,79 | 20,92 |
| Var. IRF-M 1 p.p. | 0,00 | -0,11 | -0,04 | -0,09 | -0,21 | -0,41 | -0,64 |
| BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL | 8,36 | -0,70 | 27,26 | -2,67 | 12,67 | 62,04 | 86,72 |
| Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 1,83 | 12,35 | 5,40 | 8,98 | 9,17 | 15,55 | 23,54 |
| FIA CAIXA DIVIDENDOS | 4,48 | -17,54 | 10,43 | -18,76 | -0,60 | 36,74 | 41,81 |
| Var. IBOVESPA p.p. | -3,79 | -6,53 | -17,41 | -9,22 | -1,68 | 6,84 | -14,30 |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 8,32 | -9,87 | 21,78 | -11,23 | 4,70 | 50,50 | 62,91 |
| Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 1,79 | 3,18 | -0,08 | 0,43 | 1,20 | 4,00 | -0,28 |
| FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO | 2,44 | -0,74 | 7,71 | -0,49 | 5,48 | 18,21 | 30,45 |
| % do CDI | 1.253,80 | -38,02 | 1.197,95 | -31,45 | 130,08 | 168,13 | 163,05 |
| CDI | 0,19 | 1,95 | 0,64 | 1,57 | 4,21 | 10,83 | 18,68 |
| IBOVESPA | 8,27 | -11,01 | 27,83 | -9,54 | 1,08 | 29,91 | 56,12 |
| INPC + 6% | 0,98 | 4,26 | 1,99 | 3,54 | 8,88 | 19,01 | 30,64 |
| IPCA + 6% | 0,90 | 3,91 | 1,73 | 3,16 | 8,47 | 18,63 | 31,32 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

| Indexador | No Mês | No Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | 36 meses |
|-------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|
| Renda Fixa | | | | | | | |
| IRF-M 1 | 0,24 | 2,84 | 0,94 | 2,39 | 5,51 | 13,20 | 21,56 |
| IRF-M 1+ | 1,47 | 7,59 | 4,50 | 6,40 | 12,02 | 32,81 | 43,78 |
| IRF-M TOTAL | 1,08 | 6,00 | 3,32 | 5,08 | 9,81 | 26,59 | 36,79 |
| IMA-B 5 | 0,99 | 4,19 | 4,28 | 3,61 | 8,83 | 24,16 | 34,43 |
| IMA-B 5+ | 7,32 | 1,68 | 11,51 | 1,64 | 7,81 | 49,37 | 56,19 |
| IMA-B TOTAL | 4,39 | 2,65 | 8,14 | 2,38 | 8,16 | 37,86 | 46,75 |
| IMA-C TOTAL | 4,26 | 12,04 | 11,01 | 9,27 | 15,97 | 43,97 | 64,91 |
| IMA-GERAL ex-C TOTAL | 1,66 | 3,39 | 3,57 | 2,88 | 7,07 | 23,27 | 32,25 |
| IMA-GERAL TOTAL | 1,74 | 3,64 | 3,79 | 3,07 | 7,33 | 23,84 | 33,11 |
| IDKA 2 | 0,94 | 4,31 | 3,72 | 3,76 | 8,68 | 22,37 | 33,35 |
| IDKA 20 | 12,08 | -1,74 | 17,28 | -0,38 | 4,95 | 69,37 | 71,28 |
| CDI | 0,19 | 1,95 | 0,64 | 1,57 | 4,21 | 10,83 | 18,68 |
| Renda Variável | | | | | | | |
| IBOVESPA | 8,27 | -11,01 | 27,83 | -9,54 | 1,08 | 29,91 | 56,12 |
| IBRX 100 | 8,41 | -10,43 | 28,20 | -9,30 | 2,17 | 33,69 | 59,04 |
| IBRX 50 | 8,15 | -11,06 | 29,00 | -9,35 | 0,23 | 26,69 | 52,24 |
| SMALL CAP | 9,50 | -13,20 | 31,66 | -13,59 | 7,86 | 55,28 | 71,97 |
| IFIX | -2,61 | -14,53 | 4,97 | -11,18 | 2,77 | 26,86 | 32,28 |
| Índice Consumo - ICON | 7,62 | -4,11 | 27,54 | -7,49 | 12,15 | 54,44 | 58,02 |
| Índice Dividendos - IDIV | 6,53 | -13,05 | 21,87 | -11,65 | 3,50 | 46,49 | 63,19 |
| Indicadores Econômicos | | | | | | | |
| IPCA | 0,36 | 0,46 | 0,24 | 0,25 | 2,31 | 5,60 | 10,34 |
| INPC | 0,44 | 0,80 | 0,49 | 0,61 | 2,69 | 5,94 | 9,76 |
| IGPM | 2,23 | 6,71 | 4,11 | 6,21 | 9,27 | 16,26 | 25,84 |
| SELIC | 0,19 | 1,95 | 0,64 | 1,57 | 4,21 | 10,83 | 18,69 |
| Meta Atuarial | | | | | | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

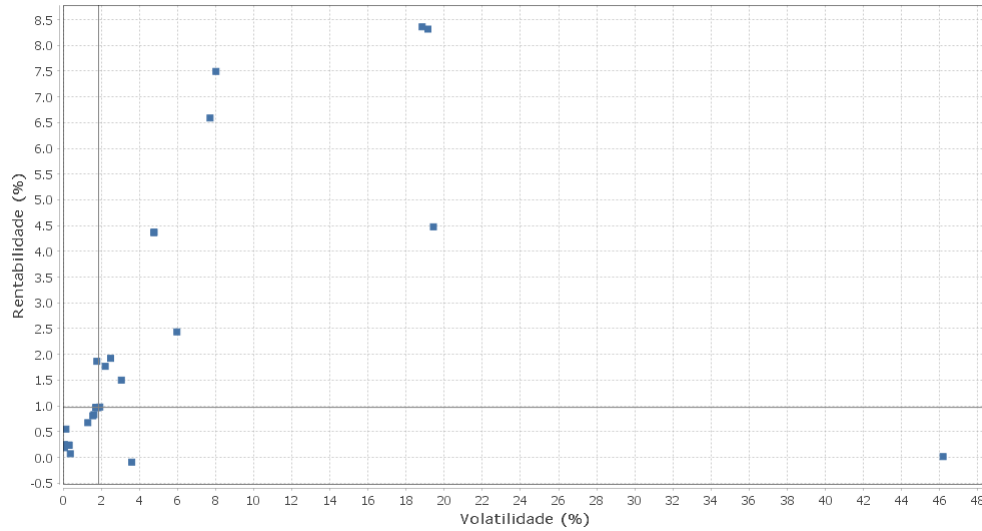
Movimentações

| APR | Data | Ativo | Aplicação | Resgate | Quantidade | Valor Cota |
|-----|------------|--|--------------|-----------|--------------------|---------------|
| 33 | 01/07/2020 | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 5.229.214,62 | 0,00 | 5.067.581,87644900 | 1,0318954380 |
| 31 | 10/07/2020 | BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI | 0,00 | 33.198,55 | 1.681,38751824 | 19,7447344200 |
| 32 | 27/07/2020 | BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF | 1.517.724,17 | 0,00 | 1.204.336,58811755 | 1,2602159400 |
| 34 | 27/07/2020 | BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | 108.083,64 | 0,00 | 103.499,47727300 | 1,0442916510 |
| 35 | 27/07/2020 | FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | 33.570,39 | 0,00 | 22.452,85757200 | 1,4951500000 |

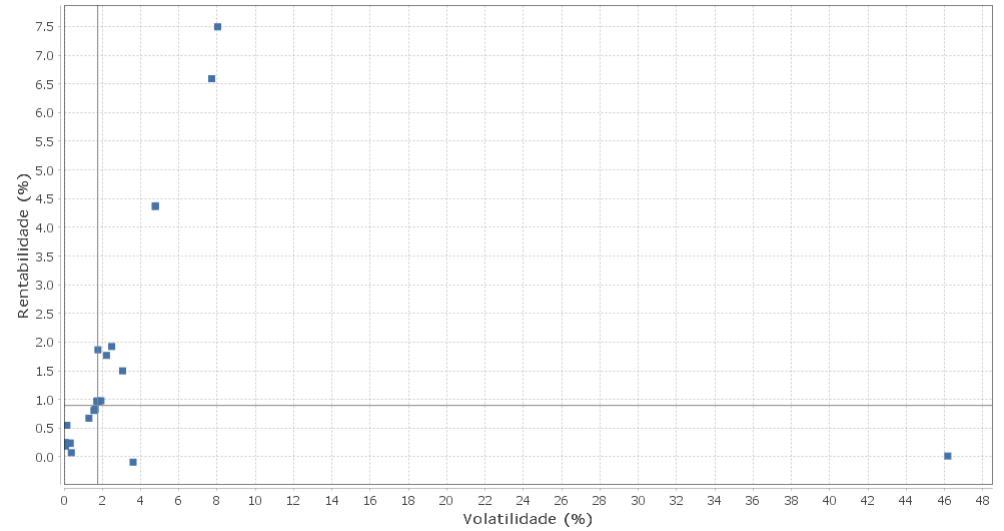
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

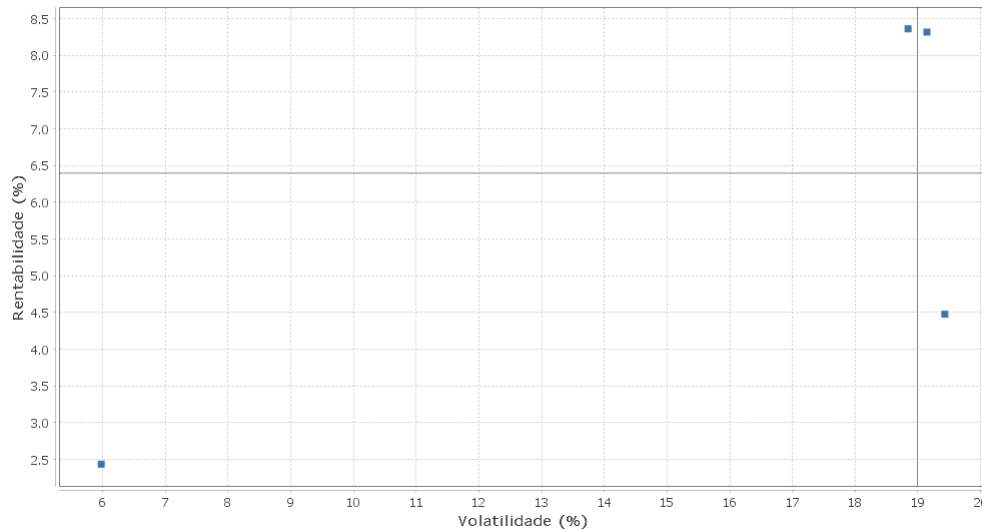
LINHARES - No Mês



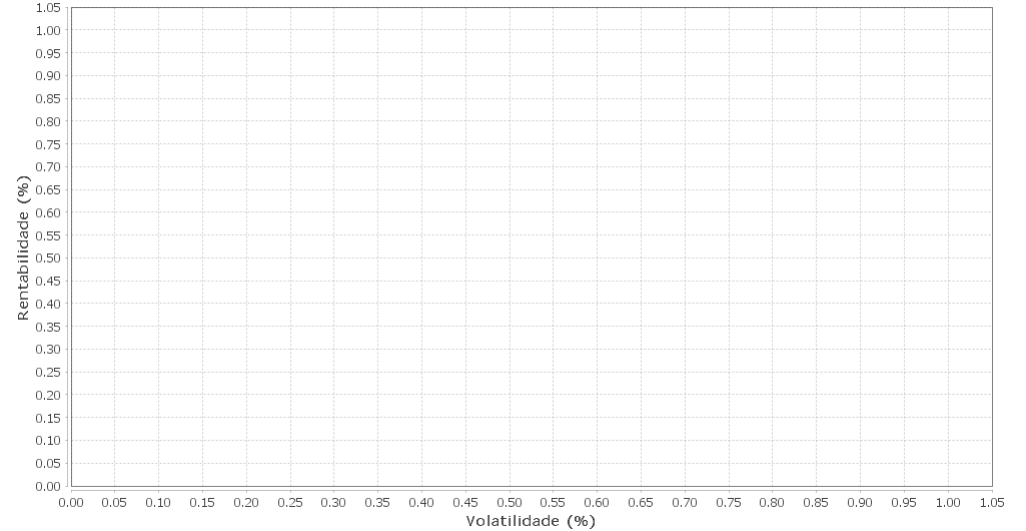
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Ativo | Estratégia | Volatilidade | VaR | Rent. | Valor(R\$) | % Carteira |
|--|------------------------|--------------|------|-------|---------------|------------|
| BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,05 | 0,02 | 0,24 | 24.446.416,65 | 8,26 |
| FI CAIXA BRASIL TITULOS PUBLICOS RF LP | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,07 | 0,02 | 0,19 | 1.136.790,47 | 0,38 |
| FI CAIXA BRASIL RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,07 | 0,02 | 0,25 | 12.178.328,64 | 4,11 |
| BANESTES VIP DI FIC DE FI RF REFERENCIADO DI | Artigo 7º IV, Alínea a | 0,15 | 0,04 | 0,55 | 19.183.187,39 | 6,48 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF | Artigo 7º I, Alínea b | 0,31 | 0,04 | 0,24 | 26.771.161,87 | 9,04 |
| BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 0,31 | 0,04 | 0,23 | 14.111.155,10 | 4,77 |
| FI CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RF | Artigo 7º I, Alínea b | 0,38 | 0,04 | 0,07 | 823.033,23 | 0,28 |
| BANESTES REFERENCIAL FI RF IRF-M1 | Artigo 7º I, Alínea b | 1,30 | 0,16 | 0,67 | 15.467.112,86 | 5,22 |
| BB PREV RF IDKA2 | Artigo 7º I, Alínea b | 1,56 | 0,20 | 0,81 | 6.211.497,42 | 2,10 |
| FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 1,62 | 0,20 | 0,83 | 9.221.012,64 | 3,11 |
| BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 1,71 | 0,22 | 0,97 | 6.386.031,02 | 2,16 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 1,74 | 0,22 | 0,97 | 9.477.089,80 | 3,20 |
| BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF | Artigo 7º IV, Alínea a | 1,77 | 0,26 | 1,86 | 11.126.020,96 | 3,76 |
| BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI | Artigo 7º I, Alínea b | 1,80 | 0,23 | 0,96 | 4.032.305,74 | 1,36 |
| FIC DE FI CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF | Artigo 7º I, Alínea b | 1,93 | 0,24 | 0,98 | 1.441.015,32 | 0,49 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI | Artigo 7º I, Alínea b | 2,21 | 0,31 | 1,77 | 12.735.524,22 | 4,30 |
| BB PREV RF ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC FI | Artigo 7º IV, Alínea a | 2,49 | 0,34 | 1,92 | 5.424.541,66 | 1,83 |
| FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TITULO | Artigo 7º I, Alínea b | 3,06 | 0,38 | 1,50 | 2.279.048,92 | 0,77 |
| NTN-B 150535 (3,200000%) | Artigo 7º I, Alínea a | 3,61 | 0,37 | -0,09 | 956.129,41 | 0,32 |
| BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI | Artigo 7º I, Alínea b | 4,76 | 0,68 | 4,36 | 17.217.771,13 | 5,82 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | Artigo 7º I, Alínea b | 4,77 | 0,68 | 4,38 | 17.506.640,83 | 5,91 |
| FI CAIXA MULTIMERCADO RV 30 LONGO PRAZO | Artigo 8º III | 5,98 | 0,72 | 2,44 | 2.721.648,95 | 0,92 |
| BANESTES INSTITUCIONAL FI RF | Artigo 7º IV, Alínea a | 7,71 | 1,08 | 6,59 | 16.007.399,11 | 5,41 |
| BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF IMA-B | Artigo 7º I, Alínea b | 8,02 | 1,15 | 7,49 | 34.553.543,62 | 11,67 |
| BANESTES FIC DE FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL | Artigo 8º II, Alínea a | 18,84 | 2,30 | 8,36 | 6.405.014,48 | 2,16 |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | Artigo 8º II, Alínea a | 19,14 | 2,33 | 8,32 | 15.563.498,97 | 5,26 |
| FIA CAIXA DIVIDENDOS | Artigo 8º II, Alínea a | 19,43 | 2,20 | 4,48 | 1.618.044,80 | 0,55 |
| NTN-B 150535 (4,410000%) | Artigo 7º I, Alínea a | 46,17 | 4,78 | 0,01 | 1.024.366,66 | 0,35 |